

长城安心回报混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2015年6月30日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	长城安心回报混合
基金代码	200007
交易代码	200007
基金合同生效日	2009年4月22日
报告期末基金份额总额	2,044,574,626.38份
投资目标	以追求高于银行一年定期存款利率,规避和减少投资组合内固定收益资产价格波动造成的投资风险为长期目标,并通过动态资产配置平衡收益与风险控制,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	奉行“自上而下”资产配置策略,根据宏观经济形势、上市公司成长能力、估值水平、行业景气度、政策预期、市场情绪等因素,动态调整股票、债券、货币、现金等资产比例,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率+银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币基金,高于债券基金和纯市场基金。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,848,305,327.47	59.99
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	信息技术业	407,865,000.00	13.24
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	121,542,400.00	3.94
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	16,146,000.00	0.52
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	82,801,000.00	2.69
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	102,150,000.00	3.33
合计		2,046,793,732.47	80.71

§3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000631	顺络电子	3,200,000	20,800,000.00	6.49
2	600121	格力电器	1,786,000	17,860,000.00	5.72
3	600276	恒立实业	3,800,000	109,252,000.00	3.40
4	300278	红日药业	7,500,000	148,300,000.00	4.56
5	600799	人福医药	3,700,000	179,085,000.00	4.45
6	000513	顺络集团	3,800,000	122,094,000.00	3.96
7	000641	华昌集团	600,000	117,000,000.00	3.70
8	600594	广汇能源	2,000,000	116,200,000.00	3.77
9	002284	吉星电子	4,000,000	114,400,000.00	3.51
10	600887	伊泰股份	6,000,000	113,400,000.00	3.68

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券		70,501,000.00	2.29
2	央行票据		-	-
3	金融债券		275,492,000.00	8.64
4	企业债券		275,492,000.00	8.64
5	企业短期融资券		-	-
6	中期票据		-	-
7	可转债		81,911,000.00	2.66
8	其他		-	-
9	合计		427,904,000.00	13.89

§5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券品种	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	国债	130215	130215张	1,500,000	166,400,000.00	4.76
2	国债	130218	1312张	500,000	51,800,000.00	1.63
3	国债	019504	151张	500,000	58,385,000.00	1.64
4	国债	130217	1312张	500,000	48,085,000.00	1.56
5	国债	130412	112张	300,000	30,787,000.00	0.99

§6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

§8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

§9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

§9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

§9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

§10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

§10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

§10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

§10.3 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

§11 投资组合报告附注

§11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

§11.2 本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

§11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,510,994.37
2	应收股利	-
3	应收利息	-
4	其他应收款	4,380,601.19
5	其他流动资产	608,269.10
6	其他资产	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,508,264.47

§11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000631	顺络电子	20,800,000.00	6.49	重大资产重组

§11.6 本基金投资的前十名债券中,是否存在计入公允价值变动损益的情况

注:本基金本报告期末,不存在计入公允价值变动损益的情况。

§6 开放式基金份额变动

报告期末基金份额总额	2,044,574,626.38
报告期期初基金份额总额	2,044,574,626.38
报告期内基金份额增减变动	0.00
报告期内基金份额减少原因	赎回(转出)、申购(转入)、转换
报告期末基金份额总额	2,044,574,626.38

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

§7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本报告报告期内,基金管理人持有本基金份额无变化,于本报告期初及期末均未持有本基金份额。

§7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期末基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

1. 基金合同
 2. 长城安心回报混合型证券投资基金基金合同
 3. 长城安心回报混合型证券投资基金托管协议
 4. 法律意见书
 5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
 6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
 7. 中国证监会规定的其他文件
- 8.2 存放地点
广东省深圳市福田区益田路6099号新世界商务中心41层
- 8.3 查阅方式
投资者可在办公时间内通过上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。
咨询电话:0755-23982338
客户服务热线:400-8868-666
公司网址: http://www.ccfund.com.cn

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,541,664,763.62
2.本期利润	1,000,689,180.60
3.本期公允价值变动损益	61,911.00
4.本期基金份额持有人收益	1,000,000,000.00
5.期末基金份额持有人收益	1,000,000,000.00

§3.1 主要财务指标

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	12.25%	2.44%	1.95%	0.80%	11.75%	2.45%

§3.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.3 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.4 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.5 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.6 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.7 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.8 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.9 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.10 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.11 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.12 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.13 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.14 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.15 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.16 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.17 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.18 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.19 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.20 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.21 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.22 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.23 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.24 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.25 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.26 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.27 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.28 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.29 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.30 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.31 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.32 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.33 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.34 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§3.35 基金业绩比较基准

注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票资产比例为基金净资产的10%-85%;现金及投资于债券类资产的比例为30%-3%;债券投资比例为基金净资产的10%-85%;现金或到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上;本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同约定。